

期權買賣交易所參與者結算運作程序

1. 引言

1.5 為聯交所期權結算所參與者在衍生產品結算及交收系統及共同抵押品管理系統維持的戶口類別

1.5.1 衍生產品結算及交收系統戶口

個別客戶戶口

為方便計算聯交所期權結算所參與者客戶持倉的淨額按金，聯交所期權結算所（在一名聯交所期權結算所參與者要求下），可全權為該聯交所期權結算所參與者開立及維持一個或多個個別客戶戶口，用作按個別客戶基準記錄聯交所期權結算所參與者客戶的交易及持倉。聯交所期權結算所可為個別聯交所期權結算所參與者設定其開立個別客戶戶口的上限。個別客戶戶口的持倉按淨額基準列賬及計算按金。聯交所期權結算所參與者須確保在每一個別客戶戶口列賬的所有交易及持倉均只屬一名客戶，且有關交易及持倉並非由一名聯交所期權結算所參與者之經營綜合戶口業務的客戶持有。聯交所期權結算所參與者須就開立、維持及終止個別客戶戶口而填報衍生產品結算及交收系統戶口維持表格〔附錄 A9〕。聯交所期權結算所可全權決定接納或拒絕任何戶口的開立及任何維持戶口要求。個別客戶戶口是為方便聯交所期權結算所參與者分別記錄持倉以達致淨額按金計算而設，不應視作認可因該個別客戶戶口而產生的任何信託或其它衡平權權益。

5. 交易及持倉管理

5.6 個別客戶戶口

屬同一客戶的持倉的按金要求可根據適用於在公司戶口記存的持倉的同一算式按淨額基準計算（請見程序第 9.3.1.1 條）。若進行有關之按金計算，聯交所期權結算所參與者須向聯交所期權結算所申請設立個別客戶戶口，而聯交所期權結算所可為個別聯交所期權結算所參與者設定其開立個別客戶戶口的上限。

附錄 G. 應付聯交所期權結算所的費用及成本

G1 [已廢除]

G3 與衍生產品結算及交收系統有關的費用

費用類別	費用
衍生產品結算及交收系統工作站或應用程式介面連接的每月支援及保養費	每工作站或應用程式介面連接每月1,750元
連接至衍生產品結算及交收系統的測試系統	每日(或不足一日)100元，首5個營業日不收連接費用
於聯交所期權結算所正常工作時間以外進行登入測試或交易測試	每日(或不足一日)1,000元(不論測試結果)
程式介面認證	每次測試2,000元(不論測試結果)

G4 與共同抵押品管理系統有關的費用

費用類別	費用
共同抵押品管理系統智能卡讀卡器	每個 300 元
共同抵押品管理系統智能卡	每張 250 元

G5 緊急費用

費用類別	費用
代參與者處理	每宗交易50元 (每日最低費用500元)
複印報表	每頁5元 最高收費為每份報表 或每隻磁碟1,000元